

长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)

[2013] 第四季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2014年1月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告期间不承担所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和报告编制机构根据有关法律法规的规定，履行了监督职责，但并不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 长盛沪深300指数(场内简称:长盛300)

基金主代码 160807

交易代码 160807

基金运作方式 约约型开放式

基金合同生效日 2010年4月4日

报告期末基金份额总额 171,150,229.64份

本基金为指数化投资，跟踪沪深300指数，通过严格的的投资纪律和数量化投资管理手段，力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度和年度跟踪误差绝对值分别小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%，以实现对基准指数的有效跟踪。

投资目标 本基金采用复制指数的投资策略，综合考虑指标的指数样本中个股的自由流通市值规模、行业代表性、波动性与标的指数的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度和年度跟踪误差绝对值分别小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%的投资目标。

投资策略 本基金主要投资于股票，股票投资组合占基金资产净值比例不低于80%；并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券，其金额不得超过基金资产净值的5%。

风险收益特征 本基金是股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

基金管理人 长盛基金管理有限公司

基金托管人 招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -5,310,396.06

2.本期利润 -5,544,642.29

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0306

4.期末基金份额净值 134,125,629.58

5.期末基金份额净值 0.784

注:1.本基金业绩指标不包括基金持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于不计费用的水平。

2.所列数据截止至2013年12月31日。

3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本基金期内实现的公允价值变动收益。

4.2.2 报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末持有积极投资的股票。

5.3 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.1 本报告期份额净值增长率及其与同期比较基本收益性的比较

注:本基金报告期份额净值增长率及其与同期比较基本收益性的比较

5.3.2 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.3 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.4 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.5 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.6 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.7 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.8 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.9 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.10 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.11 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.12 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.13 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.14 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.15 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.16 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.17 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.18 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.19 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.20 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.21 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.22 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.23 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.24 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.25 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.26 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.27 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.28 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.29 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.30 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.31 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.32 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.33 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.34 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.35 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.36 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.37 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.38 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.39 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.40 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.41 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.42 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.43 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.44 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.45 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.46 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.47 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.48 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.49 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.50 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.51 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.52 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.53 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.54 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.55 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.56 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.57 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.58 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.59 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.60 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.61 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.62 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.63 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.64 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.65 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.66 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.67 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.68 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.69 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.70 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.71 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.72 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.73 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.74 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.75 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.76 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.77 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.78 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.79 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.80 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.81 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.82 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.83 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.84 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.85 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.86 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.87 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.88 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.89 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.90 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.91 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.92 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.93 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.94 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.95 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.96 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.97 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.98 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.99 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.100 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.101 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.102 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.103 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.104 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.105 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.106 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.107 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.108 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.109 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.110 本报告期份额净值增长率及其与同期比较

5.3.11